

OBSAH

Předmluva	7
1. Předmět a metody ekonometrie	9
1.1. Podstata ekonometrie	9
1.2. Metodologie ekonometrické analýzy	11
1.2.1 Specifikace ekonometrického modelu	13
1.2.2 Kvantifikace ekonometrického modelu	21
1.2.3 Verifikace ekonometrického modelu	24
1.3. Oblasti a cíle aplikace ekonometrických modelů	28
Cvičení	31
Literatura	31
2. Odhad klasického lineárního regresního modelu	33
2.1. Klasický lineární regresní model	33
2.2. Metoda nejmenších čtverců	36
2.3. Vlastnosti odhadové funkce nejmenších čtverců při malých výběrech	41
2.4. Vlastnosti odhadové funkce nejmenších čtverců při velkých výběrech	44
2.5. Statistická indukce v klasickém lineárním regresním modelu	46
2.5.1 Testování významnosti odhadnutých parametrů	46
2.5.2 Intervaly spolehlivosti odhadnutých parametrů	49
2.5.3 Test shody odhadnutého modelu s daty	51
2.6. Prezentace odhadnutého lineárního regresního modelu	55
Cvičení	57
Literatura	58
3. Speciální problémy lineárního regresního modelu	61
3.1. Aplikace nejmenších čtverců na nelineární vztahy	61
3.2. Umělé proměnné	65
3.2.1 Regresní model obsahující pouze kvalitativní vysvětlující proměnné.....	67

3.2.2 Regresní model obsahující kvalitativní i kvantitativní vysvětlující proměnné	69
3.3. Specifikační chyby	73
3.3.1 Druhy specifikačních chyb	73
3.3.2 Testování specifikace modelu	75
3.4. Chyby měření	78
3.4.1 Pomocné proměnné	82
3.4.2 Metoda skupinových průměrů	83
Cvičení	85
Literatura	86
4. Odhad zobecněného lineárního regresního modelu	87
4.1. Nedodržení předpokladů týkajících se náhodných složek	87
4.1.1 Metoda zobecněných nejmenších čtverců	89
4.1.2 Heteroskedasticita	91
4.1.3 Autokorelace	100
4.2. Multikolinearita	113
4.2.1 Zjišťování a ověřování významnosti multikolinearity	116
4.2.2 Postup v případě významné multikolinearity	119
Cvičení	122
Literatura	125
5. Modely obsahující zpožděné proměnné	127
5.1. Podstata a struktura zpožděných proměnných	127
5.2. Modely geometricky rozděleného nekonečného zpoždění	132
5.2.1 Koyckova transformace	132
5.2.2 Model částečného přizpůsobení	135
5.2.3 Model adaptivních očekávání	137
5.2.4 Hypotéza racionálních očekávání	141
5.3. Modely konečně rozděleného zpoždění	143
5.3.1 Aritmetické zpoždění	144
5.3.2 Polynomické zpoždění Almonové	145
Cvičení	148
Literatura	150

6. Modely diskrétní volby	153
6.1. Modely binární volby	153
6.1.1 Lineární pravděpodobnostní model	154
6.1.2 Nelineární pravděpodobnostní modely	158
6.2. Modely obecné volby	163
6.2.1 Multinomický logitový model	166
6.2.2 Multinomický probitový model	171
Cvičení	172
Literatura	174
7. Modely simultánně závislých rovnic	177
7.1. Podstata simultánních vztahů	178
7.2. Základní tvary MSR v maticovém vyjádření	184
7.2.1 Strukturní tvar	184
7.2.2 Redukovaný tvar	185
7.2.3 Konečný tvar	187
7.3. Identifikace strukturních simultánních rovníc	189
7.3.1 Podstata a význam identifikace	190
7.3.2 Kritéria identifikace	194
7.4. Rekurzivní MSR	199
Cvičení	202
Literatura	204
8. Odhad lineárního modelu simultánních rovnic	205
8.1. Metody odhadu strukturních simultánních rovníc	206
8.1.1 Dvoustupňové nejmenší čtverce	208
8.1.2 Asymptotické standardní chyby odhadové funkce M2NČ	214
8.2. Odhad redukovaného tvaru MSR	217
8.3. Srovnání různých metod odhadu simultánních rovnic	220
Cvičení	223
Literatura	224